

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 2.1%, đóng cửa tại 1,410 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, HPG (-1.1%), TCB (-5.4%), và VPB (-3.9%) tạo áp lực giảm điểm đáng kể lên chỉ số VN30 trong khi VNM (+0.8%) có diễn biến tích cực hơn so với chỉ số. Về hoạt động khối ngoại, giá trị mua ròng ở mức 235 tỷ đồng. Cụ thể, VPB, VCB, và NVL chịu áp lực bán cao nhất trong khi HPG, VHM, và SSI thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đò thị VN30 Future: Vùng hỗ trợ quan trọng vẫn được giữ

VN30F2107 tiếp tục giảm mạnh trong phiên giao dịch trước nhưng vẫn giữ được ngưỡng hỗ trợ quan trọng (1,400 điểm). Vị thế mua buộc phải dừng lỗ, tín hiệu cho sự duy trì của áp lực giảm điểm. Cụ thể, vùng 1,400 điểm tiếp tục là vùng hỗ trợ ngắn hạn trong khi vùng 1,540 điểm sẽ là vùng kháng cự quan trọng cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Nếu ngưỡng 1,400 điểm bị phá vỡ, vùng 1,350 điểm sẽ là vùng hỗ trợ tiếp theo. Lực cầu vẫn chưa đủ mạnh để hình thành nhịp hồi khi các đường MA chủ đạo vẫn di chuyển hướng xuống. Đáng chú ý, hợp đồng này sẽ đáo hạn vào hôm nay, điều này hàm ý rằng mọi vị thế phải được đóng trong phiên. Tuy nhiên, mở vị thế bán mới quanh vùng hỗ trợ quan trọng sẽ rất rủi ro và vẫn chưa có bất kỳ tín hiệu nào cho vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Traders nên đứng ngoài quan sát và chờ điểm mua/bán mới từ hợp đồng tiếp theo (VN30F2108).

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,410.3	(2.1)					
VN30F2107	1,409.0	(2.6)	321,671	28,687	1,345	15/07/21	3
VN30F2108	1,412.9	(2.2)	12,056	7,617	1,345	19/08/21	38
VN30F2109	1,417.4	(0.8)	131	242	1,346	16/09/21	66
VN30F2112	1,406.0	(2.5)	104	240	1,312	16/12/21	157

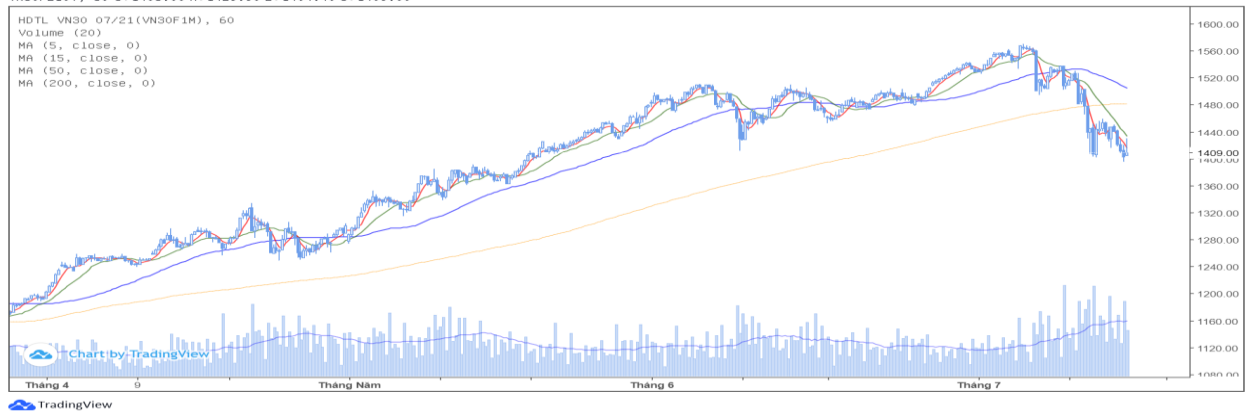
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

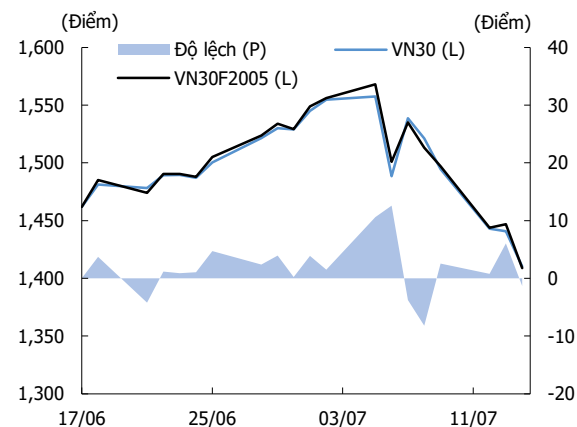
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, July 15, 2021 08:02:18 +07
VN30F2107, 60 O:1405.00 H:1429.90 L:1404.40 C:1409.00



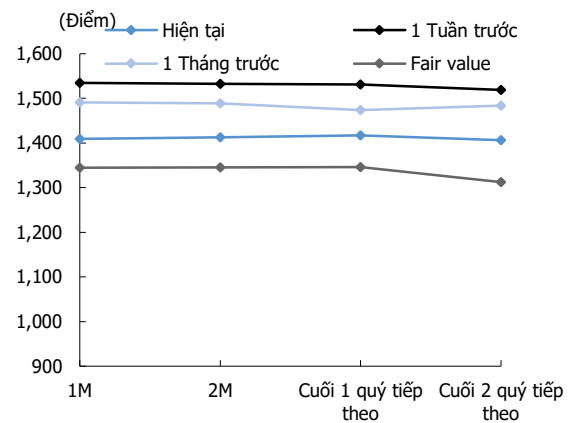
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



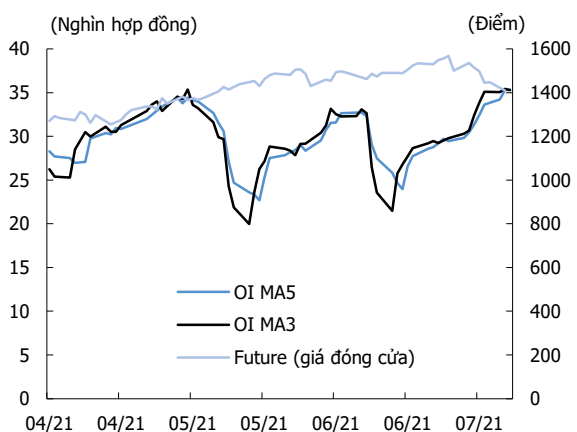
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



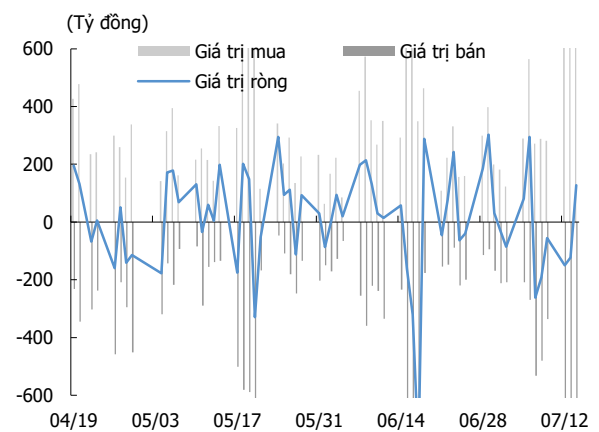
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 4. Open interest



Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 5. Giao dịch khối ngoại hàng ngày



Nguồn: Bloomberg, KIS

Bảng 2. Danh sách cổ phiếu VN30

(Tỷ đồng, đồng, %, x, nghìn CP)

Mã	Tên	Ngành	Vốn hóa	Tỷ trọng	Giá đóng cửa	% ngày	PER	PBR	KLGD 3 tháng	SH Nước Ngoài	Cao 52 Tuần	Thấp 52 Tuần
BID	NHTMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Tài chính	171,338	0.59	42,600	0.5	20.8	2.17	4,178	16.7	50,600	35,550
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	37,116	0.32	50,000	(1.4)	19.6	1.81	1,164	26.9	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	161,955	2.81	33,700	(2.6)	9.1	1.78	22,925	24.7	42,535	15,805
FPT	CTCP FPT	CNTT	77,316	5.37	85,200	(2.1)	20.8	4.62	2,835	49.0	95,000	37,913
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	174,744	0.76	91,300	(0.2)	23.1	3.46	1,002	2.8	98,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	52,037	3.16	32,650	(3.8)	10.6	2.12	5,789	17.9	37,900	13,879
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	201,282	9.61	45,000	(1.1)	11.1	3.05	35,048	26.6	56,300	15,667
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	22,930	1.19	36,800	1.4	18.9	2.71	4,124	33.0	38,100	19,697
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	109,005	5.68	28,850	(3.2)	10.8	2.12	30,791	21.7	32,926	9,797
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	137,178	4.17	116,200	1.0	90.7	8.44	2,263	33.3	122,500	48,900
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	79,139	4.47	166,500	(4.9)	18.4	4.58	958	49.0	179,900	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	153,255	4.64	104,000	(0.7)	33.7	4.80	3,177	9.3	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	42,593	1.48	87,500	0.6	32.4	8.00	4,212	4.0	97,500	17,532
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	63,310	0.71	50,900	(0.2)	17.5	2.70	2,824	17.3	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,827	1.52	96,000	(3.2)	19.3	3.79	563	49.0	109,100	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	24,473	0.42	10,450	(0.9)	10.1	0.85	12,105	3.0	15,200	8,660
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	15,793	0.62	51,100	(1.5)	8.1	1.33	694	49.0	61,000	31,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	10,800	0.33	17,500	(2.8)	15.5	1.36	3,395	8.6	25,300	13,100
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	33,401	1.74	51,000	(1.5)	18.4	2.89	14,844	47.6	59,000	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	49,420	4.08	27,400	(4.5)	18.3	1.66	38,483	13.7	33,900	9,900
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	178,750	10.09	51,000	(5.4)	12.5	2.28	19,168	22.5	58,600	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,624	0.36	19,100	(2.8)	7.5	1.32	5,696	13.5	27,400	17,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	35,365	1.77	33,000	(5.2)	8.7	1.90	5,721	30.0	40,900	15,878
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	377,564	3.61	101,800	(1.5)	17.8	3.74	2,136	23.7	117,200	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	360,202	4.72	109,500	0.0	13.9	3.95	4,910	23.2	120,400	70,900
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	348,390	5.47	103,000	0.0	47.4	4.32	2,248	15.8	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	63,369	2.75	117,000	(2.4)	30.1	4.19	558	18.4	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	177,646	7.71	85,000	0.8	18.2	5.67	3,924	55.0	117,200	84,200
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	150,967	8.52	61,500	(3.9)	13.3	2.70	28,356	15.4	73,300	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	64,193	1.34	28,250	1.4	24.0	2.13	6,224	30.5	38,300	25,050

Nguồn: Bloomberg, KIS

Miễn Trừ Trách Nhiệm

Báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing cho chứng khoán Việt Nam được thực hiện và phát hành bởi phòng phân tích của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam, công ty được cấp giấy phép đầu tư của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước Việt Nam. Chuyên viên phân tích, người thực hiện và phát hành báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing, được cấp chứng chỉ hành nghề và được quản lý bởi UBCKNN Việt Nam. Báo cáo này không được sao chụp, nhân bản hoặc xuất bản (toàn bộ hoặc từng phần) hoặc tiết lộ cho bất kỳ người nào khác mà không được sự chấp thuận bằng văn bản của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam.

Báo cáo này được viết nhằm mục đích chỉ cung cấp thông tin. Bản báo cáo này không nên và không được diễn giải như một đề nghị mua hoặc bán hoặc khuyến khích mua hoặc bán bất cứ khoản đầu tư nào. Khi xây dựng bản báo cáo này, chúng tôi hoàn toàn đã không cân nhắc về các mục tiêu đầu tư, tình hình tài chính hoặc các nhu cầu cụ thể của các nhà đầu tư. Cho nên khi đưa ra các quyết định đầu tư cho riêng mình các nhà đầu tư nên dựa vào đánh giá cá nhân hoặc tư vấn của chuyên gia tư vấn tài chính độc lập của mình và tùy theo tình hình tài chính cá nhân, mục tiêu đầu tư và các quan điểm thích hợp khác trong từng hoàn cảnh. CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam không đảm bảo nhà đầu tư sẽ đạt được lợi nhuận hoặc được chia sẻ lợi nhuận từ các khoản đầu tư. CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam, hoặc các bên liên quan, và các nhân sự cấp cao, giám đốc và nhân viên tuyên bố miễn trừ trách nhiệm với các khoản lỗ hoặc tổn thất liên quan đến việc sử dụng toàn bộ hoặc một phần báo cáo này. Thông tin và nhận định có thể thay đổi bất cứ lúc nào mà không cần báo trước và có thể khác hoặc ngược với quan điểm được thể hiện trong các mảng kinh doanh khác của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam. Quyết định đầu tư cuối cùng phải dựa trên các đánh giá cá nhân của khách hàng, và báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing không thể được sử dụng như là chứng cứ cho các tranh chấp pháp lý liên quan đến các quyết định đầu tư.

Bản quyền © 2021 của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam. Báo cáo này không được sao chụp, nhân bản hoặc xuất bản (toàn bộ hoặc từng phần) hoặc tiết lộ cho bất kỳ người nào khác mà không được sự chấp thuận bằng văn bản của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam.